长城久泰沪深300指数证券投资基金
2011年半年度报告

2011年6月30日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2011年8月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 08 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....6
§4 管理人报告.....7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....11
§5 托管人报告.....11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....12
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....12
§6 半年度财务报表(未经审计).....12
6.1 资产负债表.....12
6.2 利润表.....13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....14
6.4 报表附注.....15
§7 投资组合报告.....29
7.1 期末基金资产组合情况.....29
7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合.....30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....40
7.9 投资组合报告附注.....41
§8 基金份额持有人信息.....41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....42
§9 开放式基金份额变动.....42

§10 重大事件揭示.....42
10.1 基金份额持有人大会决议.....42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....43
10.4 基金投资策略的改变.....43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....43
10.8 其他重大事件.....44
§11 备查文件目录.....46
11.1 备查文件目录.....46
11.2 存放地点.....46
11.3 查阅方式.....46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	长城久泰沪深 300 指数	
基金主代码	200002	
交易代码	前端：200002	后端：201002
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 5 月 21 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,547,828,407.43 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1) 本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。(2) 股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3) 本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	自基金合同生效至 2011 年 3 月 31 日的业绩比较基准为：95%×中信标普 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率；自 2011 年 4 月 1 日开始业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险，获取市场平均收益。

注：本基金为增强型指数基金，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，自 2011 年 4 月 1 日起，本基金所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	彭洪波	张燕
	联系电话	0755-23982338	0755-83199084
	电子邮箱	penghb@ccfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95555
传真		0755-23982328	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		杨光裕	傅育宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心 40、41 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（ 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 ）
本期已实现收益	10,585,519.29
本期利润	-54,995,885.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0350

本期加权平均净值利润率	-2.88%
本期基金份额净值增长率	-3.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,094,605,139.84
期末可供分配基金份额利润	-0.7072
期末基金资产净值	1,830,373,996.69
期末基金份额净值	1.1825
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	205.93%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.07%	1.13%	1.36%	1.13%	0.71%	0.00%
过去三个月	-4.60%	1.03%	-5.26%	1.04%	0.66%	-0.01%
过去六个月	-3.18%	1.16%	-3.20%	1.16%	0.02%	0.00%
过去一年	16.89%	1.33%	17.47%	1.32%	-0.58%	0.01%
过去三年	10.57%	1.91%	10.60%	1.90%	-0.03%	0.01%
自基金合同生效日起至今	205.93%	1.83%	167.78%	1.83%	38.15%	0.00%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D0 到 D1 区间内每个交易日收益率的合成计算而来，计算公式如下：

从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准收益率=（1+D1 日业绩比较基准收益率）×（1+D2 日业绩比较基准收益率）×……×（1+ Dn 日业绩比较基准收益率）-1

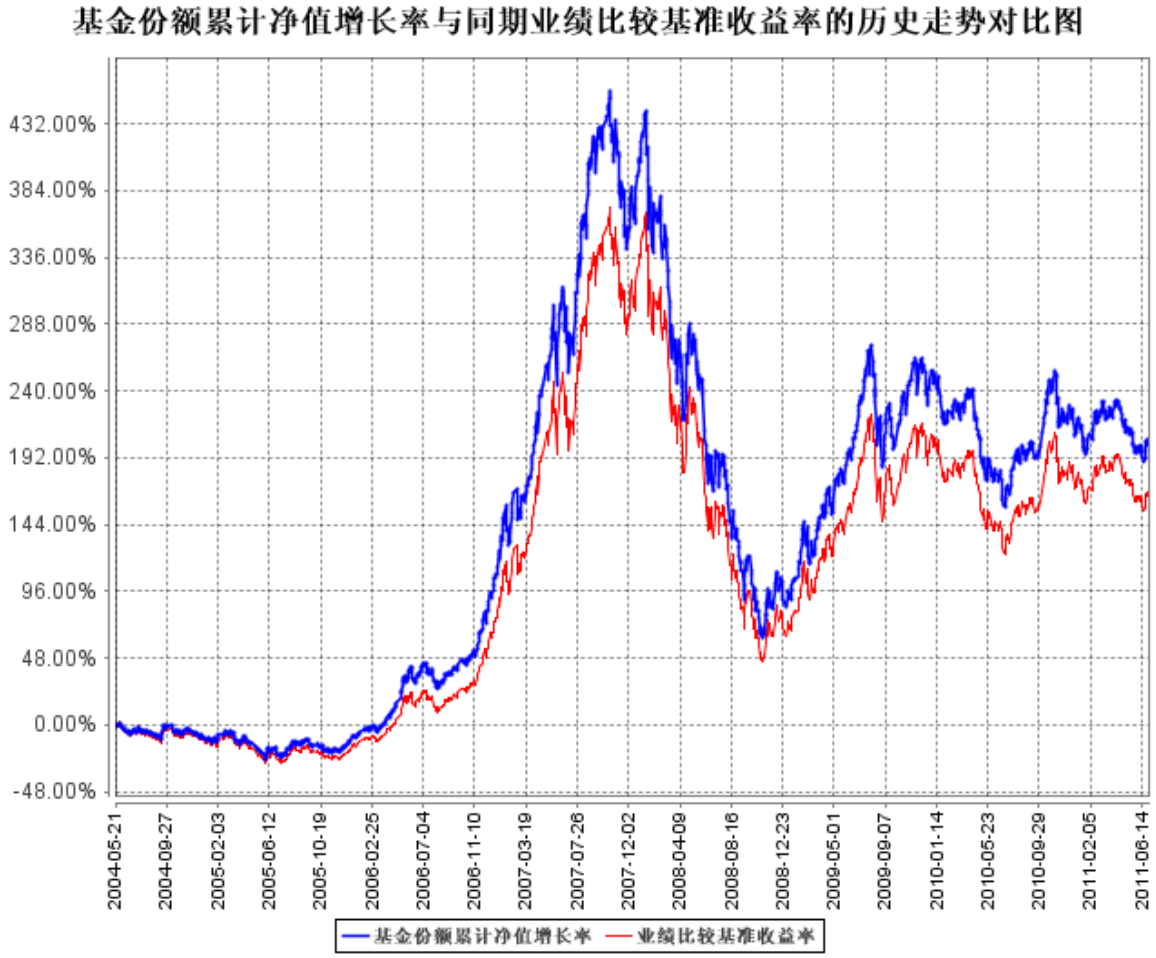
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5% ，2011 年 4 月 1 日开始长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日

收益率×95%+银行同业存款每日利率×5% 。

指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成；计算银行同业存款每日利率时，如果前一日或者多日为非交易日的，考虑该非交易日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同约定：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90～95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。本报告期末本基金的投资运作符合法律法规和基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券有限责任公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，

当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券有限责任公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金和长城积极增利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	投资总监、基金管理部总经理、本基金的基金经理、长城久富和长城中小盘基金的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	11 年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，

不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况，本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整，有效地保护了基金持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序，保证各基金获得了公平的交易机会。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为增强指数型基金，投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为，未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，中国经济依然面临较为严峻的外部环境，美国第二轮量化宽松政策实施完毕后，经济依然复苏乏力，失业率居高不下，房地产市场萎靡不振，而欧洲主权债务危机依然此起彼伏。在这种情势下更发生了日本地震及海啸引发的核危机对全球相关产业链的冲击，以及中东政局动荡尤其是利比亚危机直接将国际油价推高到 100 美元附近。国内经济形势也错综复杂，伴随着通胀逐月走高，控制通胀成为上半年经济政策的主要目标。央行动用了两次加息、每月提高存款准备金率的紧缩措施，同时房产税试点、限购、房价调控目标等措施都陆续出台，但是政策力度和效果还未显现，长江中下游地区由旱转涝更加重了对通胀的担忧。为缓冲控制通胀对经济增长的不利影响，政府政府推出了 1000 万套保障住房建设、加大水利建设等措施。在外需和国内消费短期内无法快速提升的情况下，投资成为“保增长”的重要手段，这在证券市场也得到了充分的反应，上半年和固定资产投资相关的钢铁、水泥、煤炭、机械等行业个股以及银行、地产等静态估值较低的调整充分的蓝筹股在报告期内都曾有良好的表现，上年度业绩和估值被不同程度透支的中小盘股，在一季报业绩不及预期、估值偏高等压力下，出现大幅度回落，消费类个股也在消费意愿下降、规范商业预付卡、药品限价等政策措施的影响下持续调整。二季度末市场出现风格转换的迹象，景气度高涨的白酒、调整充分的医药、零售行业逐步企稳反弹。本基金报告期内进行了目标指数的调整，将跟踪标的更换为更有代表性和影响力的沪深 300 指数。本基金严格遵守基

金合同，报告期内侧重于跟踪目标指数，努力控制跟踪误差，操作策略基本得当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金目标指数涨幅为-3.42％，本基金比较基准收益率为-3.20%，本基金份额净值增长率为-3.18%，微幅超过比较基准 0.02％，本报告期日累计跟踪误差为 0.0438%（年化指标为 0.6784%）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年连续出台的调控政策将产生一定的效果，政府在保增长和控通胀中寻求的平衡也基本上能够实现。我们认为，下半年通胀形势有望得到缓解，6 月末银行间拆借利率超过 8%说明资金面的紧张程度已经迫近临界点，政策将有结构性的微调。而政府推出的年内开工 1000 万套保障房、加大水利建设投入的政策目标陆续落实也使年内的经济继续保持较快增长毫无悬念，对宏观经济“硬着陆”的担忧更是杞人忧天。但是从长远看，我们对依赖投资保增长的方式持保留态度，对经济结构转型的必要性深信不疑，但是这并不意味着我们对投资领域蕴含的投资机会视而不见。因此，总体判断，下半年证券市场面临的宏观经济及政策环境将好于上半年，在投资者普遍调低对上市公司业绩预期的前提下，部分上市公司的业绩也许会给投资者带来惊喜，这些都预示着下半年市场将趋于活跃。我们将通过对基金合同的严格遵守，对跟踪误差的严格控制，将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了基金估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司分管估值业务副总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席基金估值委员会。

基金估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因数，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据基金估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法

及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

基金估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。 基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。 本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》规定的收益分配原则为：基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成。

截止本报告期末，本基金可供分配利润为-1,094,605,139.84 元，不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金
报告截止日： 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	96,556,460.86	113,434,860.68
结算备付金		42,189.78	109,523.71
存出保证金		760,000.00	760,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,732,905,033.17	1,872,797,831.57
其中：股票投资		1,732,905,033.17	1,872,797,831.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	19,242.35	25,235.50
应收股利		2,251,648.47	-
应收申购款		1,774,947.30	1,143,283.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,834,309,521.93	1,988,270,734.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4,694,643.32
应付赎回款		1,024,291.14	2,004,121.86
应付管理人报酬		1,428,736.44	1,676,955.78
应付托管费		291,578.90	342,235.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	506,625.15	779,164.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	684,293.61	565,498.78
负债合计		3,935,525.24	10,062,620.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,547,828,407.43	1,619,815,046.65
未分配利润	6.4.7.10	282,545,589.26	358,393,067.42
所有者权益合计		1,830,373,996.69	1,978,208,114.07
负债和所有者权益总计		1,834,309,521.93	1,988,270,734.67

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1825 元，基金份额总额 1,547,828,407.43 份。

6.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金
本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-42,455,222.49	-624,031,723.85
1.利息收入		391,707.37	431,218.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	390,747.77	429,376.27
债券利息收入		959.60	1,841.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,449,671.41	9,549,022.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,804,583.26	-2,817,190.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	440,674.60	81,974.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	15,204,413.55	12,284,237.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-65,581,404.80	-634,586,304.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	284,803.53	574,340.15
二、费用		12,540,663.02	13,593,733.91
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	9,277,950.02	10,518,421.03
2．托管费	6.4.10.2.2	1,893,459.20	2,146,616.54
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	1,186,407.36	745,869.21
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	182,846.44	182,827.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-54,995,885.51	-637,625,457.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-54,995,885.51	-637,625,457.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金
本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,619,815,046.65	358,393,067.42	1,978,208,114.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-54,995,885.51	-54,995,885.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-71,986,639.22	-20,851,592.65	-92,838,231.87
其中：1.基金申购款	111,911,999.34	23,090,622.45	135,002,621.79
2.基金赎回款	-183,898,638.56	-43,942,215.10	-227,840,853.66

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,547,828,407.43	282,545,589.26	1,830,373,996.69
项目	**上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	1,902,315,858.32	709,593,903.10	2,611,909,761.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-637,625,457.76	-637,625,457.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-118,850,214.11	-51,364,609.82	-170,214,823.93
其中：1.基金申购款	237,215,507.77	52,039,750.61	289,255,258.38
2.基金赎回款	-356,065,721.88	-103,404,360.43	-459,470,082.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,783,465,644.21	20,603,835.52	1,804,069,479.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨光裕	余骏	桑煜
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监基金字（2004）51 号文《关于同意长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金设立的批复》的核准，由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 5 月 21 日正式生效，首次设立募集规模为 1,512,020,891.32 份基金份额。本基金为契

约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（”招商银行”)。

本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，并按照中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券

（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3．个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日

活期存款	96,556,460.86
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	96,556,460.86

注：本基金本期未投资于定期存款和其他存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,850,002,966.66	1,732,905,033.17	-117,097,933.49
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,850,002,966.66	1,732,905,033.17	-117,097,933.49

注：本期本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,838.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	19.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	267.76
其他	117.00
合计	19,242.35

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	506,625.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	506,625.15

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	6,305.79
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	148,765.71
预提银行间账户服务费	4,426.92
合计	684,293.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,619,815,046.65	1,619,815,046.65
本期申购	111,911,999.34	111,911,999.34
本期赎回(以"-"号填列)	-183,898,638.56	-183,898,638.56
本期末	1,547,828,407.43	1,547,828,407.43

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,156,517,342.19	1,514,910,409.61	358,393,067.42
本期利润	10,585,519.29	-65,581,404.80	-54,995,885.51

本期基金份额交易产生的变动数	51,326,683.06	-72,178,275.71	-20,851,592.65
其中：基金申购款	-79,511,783.95	102,602,406.40	23,090,622.45
基金赎回款	130,838,467.01	-174,780,682.11	-43,942,215.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,094,605,139.84	1,377,150,729.10	282,545,589.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	380,732.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,320.21
其他	5,694.68
合计	390,747.77

注：其他包括 TA 清算申购利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	418,432,841.94
减：卖出股票成本总额	411,628,258.68
买卖股票差价收入	6,804,583.26

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,576,634.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,135,000.00
减：应收利息总额	959.60
债券投资收益	440,674.60

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,204,413.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,204,413.55

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-65,581,404.80
——股票投资	-65,581,404.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-65,581,404.80

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	268,773.88
转出基金补偿收入	16,029.65
合计	284,803.53

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,186,407.36

银行间市场交易费用	-
合计	1,186,407.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
其他	100.00
银行费用	258.62
债券账户维护费	8,926.92
合计	182,846.44

注：其他为支付深圳证券账户变更费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

于本报告期，并无对本基金存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司（"长城证券"）	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	248,273,834.01	33.31%	118,512,182.22	27.17%
东方证券	497,080,734.49	66.69%	317,440,495.81	72.78%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	201,724.39	32.32%	173,240.67	34.20%
东方证券	422,518.85	67.68%	333,384.48	65.80%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	96,292.10	26.29%	32,722.05	2,772.00%
东方证券	269,824.59	73.66%	85,322.77	7,228.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,277,950.02	10,518,421.03
其中：支付销售机构的客户维护费	2,098,863.48	2,346,695.16

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.98%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.98%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,893,459.20	2,146,616.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未投资于本基金，于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	96,556,460.86	380,732.88	105,268,044.08	417,772.62

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010 年 12 月 6 日	重大事项停牌	35.60	-	-	99,117	2,433,854.12	3,528,565.20	-
000652	泰达股份	2010 年 11 月 22 日	重大事项停牌	7.68	2011 年 7 月 8 日	7.68	377,867	3,908,691.91	2,902,018.56	-
600369	西南证券	2011 年 3 月 1 日	重大事项停牌	11.87	-	-	224,639	4,020,922.19	2,666,464.93	-
000959	首钢股份	2010 年 10 月 29 日	重大事项停牌	4.42	-	-	478,220	2,693,570.87	2,113,732.40	-
600170	上海建工	2011 年 6 月 29 日	重大事项停牌	15.59	2011 年 7 月 4 日	16.25	138,345	2,641,181.77	2,156,798.55	-

注：本基金所持上海家化（股票代码 600315）因重大事项自 2010 年 12 月 06 日起停牌，根据 2011 年 1 月 18 日的公告，本基金自 2011 年 1 月 17 日起对该股票采用指数收益法进行估值，截止到本报告期末仍未复牌,估值单价为 35.60 元。上海家化 2010 年度权益分派，股权登记日为 2011 年 4 月 28 日，除息日为 2011 年 4 月 29 日，每股派发现金红利人民币 0.25 元（含税）。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于本期末未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即

为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	96,556,460.86	-	-	-	-	-	96,556,460.86
结算备付金	42,189.78	-	-	-	-	-	42,189.78
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	500,000.00	760,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,732,905,033.17	1,732,905,033.17
应收利息	-	-	-	-	-	19,242.35	19,242.35
应收股利	-	-	-	-	-	2,251,648.47	2,251,648.47
应收申购款	1,774,947.30	-	-	-	-	-	1,774,947.30
资产总计	98,633,597.94	-	-	-	-	1,735,675,923.99	1,834,309,521.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,024,291.14	1,024,291.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,428,736.44	1,428,736.44
应付托管费	-	-	-	-	-	291,578.90	291,578.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	506,625.15	506,625.15
其他负债	-	-	-	-	-	684,293.61	684,293.61
负债总计	-	-	-	-	-	3,935,525.24	3,935,525.24

利率敏感度缺口	98,633,597.94	-	-	-	-		
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	113,434,860.68	-	-	-	-	-	113,434,860.68
结算备付金	109,523.71	-	-	-	-	-	109,523.71
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	500,000.00	760,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,872,797,831.57	1,872,797,831.57
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	25,235.50	25,235.50
应收申购款	1,143,283.21	-	-	-	-	-	1,143,283.21
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	114,947,667.60	-	-	-	-	1,873,323,067.07	1,988,270,734.67
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,694,643.32	4,694,643.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,004,121.86	2,004,121.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,676,955.78	1,676,955.78
应付托管费	-	-	-	-	-	342,235.87	342,235.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	779,164.99	779,164.99
其他负债	-	-	-	-	-	565,498.78	565,498.78
负债总计	-	-	-	-	-	10,062,620.60	10,062,620.60
利率敏感度缺口	114,947,667.60	-	-	-	-		

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资，因此在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。

于本期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,732,905,033.17	94.67	1,872,797,831.57	94.67
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,732,905,033.17	94.67	1,872,797,831.57	94.67

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2011 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2010 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上升 5%	81,983,737.12	91,420,626.15
	沪深 300 指数下降 5%	-81,983,737.12	-91,420,626.15

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,732,905,033.17	94.47
	其中：股票	1,732,905,033.17	94.47
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	96,598,650.64	5.27
6	其他各项资产	4,805,838.12	0.26
7	合计	1,834,309,521.93	100.00

7.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,971,153.01	0.38
B	采掘业	203,542,238.19	11.12
C	制造业	642,581,151.85	35.11
C0	食品、饮料	110,130,547.18	6.02
C1	纺织、服装、皮毛	5,788,638.66	0.32
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	46,473,299.64	2.54
C5	电子	19,027,187.79	1.04
C6	金属、非金属	156,998,785.57	8.58
C7	机械、设备、仪表	223,796,081.20	12.23
C8	医药、生物制品	73,823,711.06	4.03
C99	其他制造业	6,542,900.75	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	37,232,071.41	2.03
E	建筑业	54,263,137.46	2.96
F	交通运输、仓储业	64,834,064.51	3.54
G	信息技术业	53,876,127.75	2.94
H	批发和零售贸易	52,748,942.38	2.88
I	金融、保险业	475,949,491.16	26.00
J	房地产业	82,969,713.12	4.53
K	社会服务业	14,203,962.68	0.78
L	传播与文化产业	6,577,332.13	0.36
M	综合类	37,155,647.52	2.03
	合计	1,732,905,033.17	94.67

7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,019,661	49,219,036.47	2.69
2	600016	民生银行	8,511,174	48,769,027.02	2.66
3	601166	兴业银行	3,101,277	41,805,213.96	2.28
4	600000	浦发银行	4,065,264	40,002,197.76	2.19
5	601328	交通银行	6,199,826	34,347,036.04	1.88
6	600030	中信证券	2,326,803	30,434,583.24	1.66
7	601088	中国神华	1,009,596	30,429,223.44	1.66
8	000001	深发展Ａ	1,577,359	26,925,518.13	1.47
9	000002	万　科Ａ	3,002,801	25,373,668.45	1.39
10	600519	贵州茅台	118,837	25,268,311.31	1.38
11	600837	海通证券	2,483,076	22,397,345.52	1.22
12	000858	五 粮 液	624,685	22,313,748.20	1.22
13	601398	工商银行	4,880,883	21,768,738.18	1.19
14	601601	中国太保	960,087	21,496,347.93	1.17
15	601169	北京银行	2,142,641	21,362,130.77	1.17
16	601668	中国建筑	4,469,989	18,014,055.67	0.98
17	600585	海螺水泥	608,898	16,903,008.48	0.92
18	002024	苏宁电器	1,311,782	16,803,927.42	0.92
19	600031	三一重工	918,009	16,560,882.36	0.90
20	600015	华夏银行	1,499,388	16,298,347.56	0.89
21	600111	包钢稀土	223,702	15,979,033.86	0.87
22	601006	大秦铁路	1,859,643	15,230,476.17	0.83
23	601939	建设银行	3,063,529	15,133,833.26	0.83
24	000651	格力电器	620,124	14,572,914.00	0.80
25	000157	中联重科	876,371	13,478,585.98	0.74
26	600050	中国联通	2,561,865	13,449,791.25	0.73
27	000063	中兴通讯	453,657	12,829,419.96	0.70
28	601857	中国石油	1,130,814	12,314,564.46	0.67
29	000983	西山煤电	505,205	12,225,961.00	0.67
30	600048	保利地产	1,094,092	12,024,071.08	0.66

31	000792	盐湖股份	198,594	11,717,046.00	0.64
32	000527	美的电器	629,193	11,570,859.27	0.63
33	601899	紫金矿业	1,591,977	11,525,913.48	0.63
34	000776	广发证券	284,587	11,170,039.75	0.61
35	600104	上海汽车	589,737	11,051,671.38	0.60
36	000568	泸州老窖	242,413	10,937,674.56	0.60
37	600900	长江电力	1,504,279	10,845,851.59	0.59
38	601989	中国重工	774,825	10,684,836.75	0.58
39	002304	洋河股份	83,330	10,512,912.80	0.57
40	600089	特变电工	812,382	10,512,223.08	0.57
41	600028	中国石化	1,268,292	10,438,043.16	0.57
42	000338	潍柴动力	220,316	10,008,955.88	0.55
43	600547	山东黄金	218,323	9,789,603.32	0.53
44	600019	宝钢股份	1,527,512	9,210,897.36	0.50
45	601699	潞安环能	276,798	9,081,742.38	0.50
46	600383	金地集团	1,416,539	9,080,014.99	0.50
47	601766	中国南车	1,259,378	8,966,771.36	0.49
48	600362	江西铜业	250,994	8,895,227.36	0.49
49	600348	国阳新能	362,118	8,741,528.52	0.48
50	600887	伊利股份	518,774	8,637,587.10	0.47
51	601628	中国人寿	453,354	8,500,387.50	0.46
52	601168	西部矿业	571,991	8,476,906.62	0.46
53	601288	农业银行	2,976,352	8,333,785.60	0.46
54	600256	广汇股份	348,949	8,298,007.22	0.45
55	600489	中金黄金	300,794	8,208,668.26	0.45
56	600068	葛洲坝	612,882	7,348,455.18	0.40
57	600739	辽宁成大	256,226	7,123,082.80	0.39
58	601299	中国北车	1,060,184	7,103,232.80	0.39
59	601600	中国铝业	643,429	7,084,153.29	0.39
60	600690	青岛海尔	252,750	7,064,362.50	0.39
61	601988	中国银行	2,223,427	6,981,560.78	0.38
62	000895	双汇发展	105,594	6,976,595.58	0.38
63	000423	东阿阿胶	168,495	6,952,103.70	0.38
64	600406	国电南瑞	191,135	6,938,200.50	0.38
65	600795	国电电力	2,298,848	6,804,590.08	0.37
66	600010	包钢股份	790,541	6,601,017.35	0.36
67	000069	华侨城A	824,156	6,519,073.96	0.36
68	601688	华泰证券	526,690	6,504,621.50	0.36
69	600188	兖州煤业	180,642	6,376,662.60	0.35

70	600518	康美药业	482,528	6,350,068.48	0.35
71	000012	南　玻A	383,984	6,335,736.00	0.35
72	601390	中国中铁	1,565,190	6,245,108.10	0.34
73	000039	中集集团	284,329	6,221,118.52	0.34
74	601009	南京银行	691,724	6,204,764.28	0.34
75	000425	徐工机械	248,735	6,166,140.65	0.34
76	600309	烟台万华	326,090	6,101,143.90	0.33
77	000538	云南白药	106,064	6,054,133.12	0.33
78	601788	光大证券	434,798	5,978,472.50	0.33
79	002202	金风科技	399,004	5,957,129.72	0.33
80	000060	中金岭南	447,130	5,946,829.00	0.32
81	601919	中国远洋	715,698	5,933,136.42	0.32
82	600415	小商品城	474,536	5,832,047.44	0.32
83	000937	冀中能源	221,798	5,622,579.30	0.31
84	000709	河北钢铁	1,243,150	5,619,038.00	0.31
85	000630	铜陵有色	232,331	5,599,177.10	0.31
86	601186	中国铁建	922,582	5,581,621.10	0.30
87	601898	中煤能源	556,651	5,566,510.00	0.30
88	600875	东方电气	217,238	5,539,569.00	0.30
89	000009	中国宝安	319,317	5,498,638.74	0.30
90	000402	金 融 街	735,794	5,496,381.18	0.30
91	601618	中国中冶	1,392,513	5,486,501.22	0.30
92	000623	吉林敖东	176,297	5,431,710.57	0.30
93	600150	中国船舶	72,062	5,331,867.38	0.29
94	600276	恒瑞医药	176,581	5,292,132.57	0.29
95	601958	金钼股份	271,111	5,218,886.75	0.29
96	600005	武钢股份	1,199,685	4,978,692.75	0.27
97	000725	京东方A	1,817,129	4,960,762.17	0.27
98	601111	中国国航	513,319	4,922,729.21	0.27
99	000528	柳　　工	216,474	4,898,806.62	0.27
100	601666	平煤股份	346,650	4,856,566.50	0.27
101	002073	软控股份	231,000	4,758,600.00	0.26
102	000100	TCL 集团	1,575,616	4,711,091.84	0.26
103	600143	金发科技	285,491	4,699,181.86	0.26
104	000783	长江证券	432,380	4,656,732.60	0.25
105	000933	神火股份	304,034	4,624,357.14	0.25
106	000758	中色股份	130,666	4,619,043.10	0.25
107	600660	福耀玻璃	445,511	4,615,493.96	0.25
108	000825	太钢不锈	895,035	4,609,430.25	0.25

109	600123	兰花科创	109,642	4,580,842.76	0.25
110	600132	重庆啤酒	79,363	4,555,436.20	0.25
111	000401	冀东水泥	181,502	4,535,734.98	0.25
112	600881	亚泰集团	543,418	4,526,671.94	0.25
113	600642	申能股份	890,144	4,513,030.08	0.25
114	600058	五矿发展	130,214	4,463,735.92	0.24
115	600100	同方股份	422,608	4,420,479.68	0.24
116	600029	南方航空	552,958	4,335,190.72	0.24
117	600664	哈药股份	273,993	4,301,690.10	0.24
118	600271	航天信息	165,162	4,267,786.08	0.23
119	601607	上海医药	253,907	4,265,637.60	0.23
120	002142	宁波银行	385,389	4,193,032.32	0.23
121	600497	驰宏锌锗	189,470	4,177,813.50	0.23
122	000960	锡业股份	143,033	4,162,260.30	0.23
123	000878	云南铜业	184,795	4,048,858.45	0.22
124	000768	西飞国际	362,529	3,991,444.29	0.22
125	601106	中国一重	818,277	3,968,643.45	0.22
126	601117	中国化学	445,862	3,950,337.32	0.22
127	600655	豫园商城	362,484	3,943,825.92	0.22
128	600009	上海机场	306,581	3,924,236.80	0.21
129	600550	天威保变	215,043	3,872,924.43	0.21
130	600583	海油工程	591,967	3,800,428.14	0.21
131	600115	东方航空	725,896	3,774,659.20	0.21
132	601001	大同煤业	221,899	3,772,283.00	0.21
133	601998	中信银行	790,541	3,755,069.75	0.21
134	000869	张　裕A	38,000	3,754,400.00	0.21
135	600549	厦门钨业	90,394	3,745,023.42	0.20
136	600153	建发股份	418,750	3,726,875.00	0.20
137	600177	雅戈尔	376,622	3,717,259.14	0.20
138	600694	大商股份	95,752	3,660,598.96	0.20
139	600741	华域汽车	328,398	3,655,069.74	0.20
140	000800	一汽轿车	256,598	3,633,427.68	0.20
141	600196	复星医药	332,615	3,618,851.20	0.20
142	601333	广深铁路	878,779	3,611,781.69	0.20
143	000680	山推股份	203,392	3,577,665.28	0.20
144	002106	莱宝高科	118,000	3,569,500.00	0.20
145	600600	青岛啤酒	103,493	3,533,251.02	0.19
146	600315	上海家化	99,117	3,528,565.20	0.19
147	601101	昊华能源	55,528	3,504,372.08	0.19

148	000778	新兴铸管	329,244	3,473,524.20	0.19
149	600352	浙江龙盛	362,229	3,470,153.82	0.19
150	600832	东方明珠	442,160	3,426,740.00	0.19
151	600535	天士力	82,610	3,397,749.30	0.19
152	600320	振华重工	508,985	3,384,750.25	0.18
153	601727	上海电气	484,612	3,353,515.04	0.18
154	600166	福田汽车	383,778	3,331,193.04	0.18
155	000024	招商地产	181,313	3,318,027.90	0.18
156	002007	华兰生物	97,151	3,297,304.94	0.18
157	002155	辰州矿业	100,235	3,276,682.15	0.18
158	600631	百联股份	219,381	3,264,389.28	0.18
159	000422	湖北宜化	155,850	3,261,940.50	0.18
160	601808	中海油服	181,249	3,237,107.14	0.18
161	600970	中材国际	117,737	3,217,752.21	0.18
162	600219	南山铝业	338,995	3,189,942.95	0.17
163	000969	安泰科技	163,307	3,189,385.71	0.17
164	600395	盘江股份	95,178	3,158,957.82	0.17
165	600859	王府井	76,000	3,037,720.00	0.17
166	600109	国金证券	208,700	3,036,585.00	0.17
167	600085	同仁堂	85,083	3,034,059.78	0.17
168	600418	江淮汽车	272,570	3,028,252.70	0.17
169	600376	首开股份	229,080	3,026,146.80	0.17
170	000917	电广传媒	123,946	3,024,282.40	0.17
171	000839	中信国安	290,502	3,024,125.82	0.17
172	000898	鞍钢股份	440,055	2,992,374.00	0.16
173	600267	海正药业	80,000	2,987,200.00	0.16
174	600208	新湖中宝	474,816	2,958,103.68	0.16
175	600125	铁龙物流	279,506	2,945,993.24	0.16
176	600598	北大荒	209,429	2,932,006.00	0.16
177	000729	燕京啤酒	172,092	2,920,401.24	0.16
178	600809	山西汾酒	41,647	2,917,372.35	0.16
179	002422	科伦药业	49,410	2,915,190.00	0.16
180	600997	开滦股份	182,371	2,910,641.16	0.16
181	000652	泰达股份	377,867	2,902,018.56	0.16
182	600588	用友软件	140,303	2,898,659.98	0.16
183	600169	太原重工	284,178	2,884,406.70	0.16
184	600316	洪都航空	89,447	2,882,876.81	0.16
185	600649	城投控股	353,359	2,869,275.08	0.16
186	600582	天地科技	129,220	2,860,930.80	0.16

187	600703	三安光电	174,311	2,858,700.40	0.16
188	600811	东方集团	412,099	2,835,241.12	0.15
189	601866	中海集运	772,787	2,812,944.68	0.15
190	002128	露天煤业	128,463	2,794,070.25	0.15
191	600812	华北制药	242,384	2,792,263.68	0.15
192	000728	国元证券	247,044	2,791,597.20	0.15
193	600331	宏达股份	207,517	2,762,051.27	0.15
194	000562	宏源证券	165,116	2,759,088.36	0.15
195	600066	宇通客车	119,019	2,754,099.66	0.15
196	000061	农 产 品	169,372	2,703,177.12	0.15
197	600108	亚盛集团	439,843	2,669,847.01	0.15
198	600369	西南证券	224,639	2,666,464.93	0.15
199	600216	浙江医药	84,807	2,662,091.73	0.15
200	000059	辽通化工	195,486	2,654,699.88	0.15
201	601818	光大银行	790,541	2,648,312.35	0.14
202	600118	中国卫星	116,755	2,616,479.55	0.14
203	600804	鹏博士	331,465	2,615,258.85	0.14
204	600516	方大炭素	197,636	2,594,960.68	0.14
205	600893	航空动力	150,080	2,594,883.20	0.14
206	600062	双鹤药业	104,334	2,586,439.86	0.14
207	601377	兴业证券	150,000	2,584,500.00	0.14
208	600839	四川长虹	766,935	2,561,562.90	0.14
209	600595	中孚实业	253,243	2,542,559.72	0.14
210	600018	上港集团	651,623	2,541,329.70	0.14
211	600508	上海能源	103,374	2,519,224.38	0.14
212	601018	宁波港	780,000	2,496,000.00	0.14
213	600879	航天电子	203,618	2,475,994.88	0.14
214	000876	新 希 望	123,818	2,470,169.10	0.13
215	002092	中泰化学	187,831	2,464,342.72	0.13
216	600239	云南城投	190,766	2,453,250.76	0.13
217	601158	重庆水务	296,453	2,448,701.78	0.13
218	600808	马钢股份	701,432	2,440,983.36	0.13
219	601179	中国西电	394,122	2,404,144.20	0.13
220	600432	吉恩镍业	106,305	2,368,475.40	0.13
221	600221	海南航空	328,357	2,344,468.98	0.13
222	600635	大众公用	395,167	2,331,485.30	0.13
223	000999	华润三九	127,116	2,281,732.20	0.12
224	600895	张江高科	238,708	2,253,403.52	0.12
225	002122	天马股份	175,802	2,250,265.60	0.12

226	000968	煤 气 化	88,106	2,231,724.98	0.12
227	601918	国投新集	183,298	2,228,903.68	0.12
228	000625	长安汽车	240,546	2,200,995.90	0.12
229	600779	水井坊	97,881	2,194,492.02	0.12
230	600500	中化国际	217,004	2,167,869.96	0.12
231	600170	上海建工	138,345	2,156,798.55	0.12
232	600528	中铁二局	245,597	2,134,237.93	0.12
233	600266	北京城建	141,310	2,126,715.50	0.12
234	000959	首钢股份	478,220	2,113,732.40	0.12
235	000807	云铝股份	196,371	2,112,951.96	0.12
236	600220	江苏阳光	410,988	2,071,379.52	0.11
237	600428	中远航运	285,473	2,061,115.06	0.11
238	601888	中国国旅	85,636	2,023,578.68	0.11
239	002001	新 和 成	68,464	2,016,264.80	0.11
240	600481	双良节能	138,185	1,998,155.10	0.11
241	600717	天津港	243,177	1,989,187.86	0.11
242	600037	歌华有线	194,367	1,980,599.73	0.11
243	600675	中华企业	286,897	1,950,899.60	0.11
244	600456	宝钛股份	66,924	1,931,426.64	0.11
245	002146	荣盛发展	196,927	1,929,884.60	0.11
246	600269	赣粤高速	405,747	1,911,068.37	0.10
247	000718	苏宁环球	236,453	1,891,624.00	0.10
248	000780	平庄能源	118,582	1,885,453.80	0.10
249	600546	山煤国际	60,300	1,880,757.00	0.10
250	000612	焦作万方	104,754	1,868,811.36	0.10
251	002493	荣盛石化	60,000	1,853,400.00	0.10
252	600096	云天化	92,904	1,847,860.56	0.10
253	000027	深圳能源	244,279	1,841,863.66	0.10
254	002500	山西证券	200,000	1,830,000.00	0.10
255	600312	平高电气	179,903	1,826,015.45	0.10
256	000031	中粮地产	315,745	1,806,061.40	0.10
257	000690	宝新能源	353,703	1,775,589.06	0.10
258	600823	世茂股份	118,582	1,734,854.66	0.09
259	600008	首创股份	302,292	1,710,972.72	0.09
260	600863	内蒙华电	192,158	1,702,519.88	0.09
261	600971	恒源煤电	42,000	1,695,120.00	0.09
262	600151	航天机电	145,755	1,680,555.15	0.09
263	600674	川投能源	117,174	1,680,275.16	0.09
264	000021	长城开发	200,527	1,660,363.56	0.09

265	601718	际华集团	360,000	1,656,000.00	0.09
266	600380	健康元	177,872	1,638,201.12	0.09
267	002244	滨江集团	132,416	1,628,716.80	0.09
268	600026	中海发展	190,575	1,608,453.00	0.09
269	601717	郑煤机	44,000	1,604,240.00	0.09
270	600183	生益科技	173,503	1,592,757.54	0.09
271	601098	中南传媒	165,000	1,572,450.00	0.09
272	600737	中粮屯河	148,435	1,521,458.75	0.08
273	600307	酒钢宏兴	276,690	1,516,261.20	0.08
274	601558	华锐风电	51,000	1,490,730.00	0.08
275	600517	置信电气	120,964	1,460,035.48	0.08
276	600161	天坛生物	82,395	1,396,595.25	0.08
277	000686	东北证券	69,409	1,395,120.90	0.08
278	002294	信立泰	39,528	1,327,745.52	0.07
279	600718	东软集团	110,388	1,256,215.44	0.07
280	002028	思源电气	91,140	1,247,706.60	0.07
281	000559	万向钱潮	155,000	1,246,200.00	0.07
282	002399	海普瑞	32,054	1,240,810.34	0.07
283	601107	四川成渝	217,399	1,221,782.38	0.07
284	601369	陕鼓动力	111,171	1,219,545.87	0.07
285	600004	白云机场	148,227	1,169,511.03	0.06
286	002415	海康威视	29,646	1,164,791.34	0.06
287	601933	永辉超市	46,000	1,112,740.00	0.06
288	000961	中南建设	99,800	1,051,892.00	0.06
289	000685	中山公用	59,291	986,602.24	0.05
290	600300	维维股份	189,589	976,383.35	0.05
291	002405	四维图新	29,646	923,472.90	0.05
292	000951	中国重汽	49,409	913,078.32	0.05
293	002310	东方园林	10,000	900,000.00	0.05
294	002498	汉缆股份	43,297	836,931.01	0.05
295	002069	獐 子 岛	31,000	753,300.00	0.04
296	600998	九州通	60,000	741,000.00	0.04
297	000927	一汽夏利	98,818	697,655.08	0.04
298	002385	大北农	19,764	640,353.60	0.03
299	601118	海南橡胶	50,000	616,000.00	0.03
300	000536	华映科技	20,100	466,722.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	11,902,267.19	0.60
2	601989	中国重工	10,226,518.00	0.52
3	000776	广发证券	9,936,208.70	0.50
4	002304	洋河股份	8,827,756.58	0.45
5	601288	农业银行	8,360,000.00	0.42
6	601009	南京银行	8,172,406.09	0.41
7	600837	海通证券	7,576,144.57	0.38
8	601668	中国建筑	7,516,662.95	0.38
9	601600	中国铝业	7,284,558.17	0.37
10	601688	华泰证券	6,959,806.43	0.35
11	601788	光大证券	6,873,939.12	0.35
12	600362	江西铜业	6,523,781.46	0.33
13	600010	包钢股份	6,290,700.70	0.32
14	000792	盐湖股份	6,120,300.39	0.31
15	000063	中兴通讯	5,798,410.31	0.29
16	600115	东方航空	5,520,000.00	0.28
17	002142	宁波银行	5,411,777.55	0.27
18	601006	大秦铁路	5,194,177.89	0.26
19	000725	京东方Ａ	4,911,194.48	0.25
20	002073	软控股份	4,849,497.00	0.25

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	11,487,082.60	0.58
2	600837	海通证券	6,278,906.14	0.32
3	002073	软控股份	6,238,787.10	0.32
4	601111	中国国航	6,027,857.69	0.30

5	000338	潍柴动力	6,008,821.50	0.30
6	000157	中联重科	5,967,979.38	0.30
7	000937	冀中能源	5,650,848.09	0.29
8	600030	中信证券	5,491,858.02	0.28
9	600031	三一重工	5,383,077.57	0.27
10	601668	中国建筑	5,346,543.88	0.27
11	000581	威孚高科	5,020,708.80	0.25
12	600252	中恒集团	4,840,194.98	0.24
13	600016	民生银行	4,824,286.87	0.24
14	002038	双鹭药业	4,756,425.49	0.24
15	601939	建设银行	4,249,318.30	0.21
16	600900	长江电力	4,241,198.81	0.21
17	002106	莱宝高科	4,036,664.99	0.20
18	600015	华夏银行	3,737,103.86	0.19
19	002008	大族激光	3,680,988.51	0.19
20	600770	综艺股份	3,486,119.05	0.18

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	337,316,865.08
卖出股票收入（成交）总额	418,432,841.94

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	760,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,251,648.47
4	应收利息	19,242.35
5	应收申购款	1,774,947.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,805,838.12

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
96,226	16,085.34	24,275,310.32	1.57%	1,523,553,097.11	98.43%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	110,200.39	0.0071%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 5 月 21 日）基金份额总额	1,512,020,891.32
本报告期期初基金份额总额	1,619,815,046.65
本报告期基金总申购份额	111,911,999.34
减:本报告期基金总赎回份额	183,898,638.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,547,828,407.43

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

因任期届满，并经第四届董事会第一次会议审议并决议，关林戈先生不再担任公司总经理；韩浩先生不再担任公司副总经理；彭洪波先生不再担任公司督察长；在新任总经理到任前，由余骏先生代为履行公司总经理职责；在新任督察长到任前，由彭洪波先生代为履行公司督察长职责。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

公司总行资产托管部原总经理夏博辉同志已调离招商银行，根据公司招银发[2011]331 号文，夏博辉先生不再担任公司总行资产托管部总经理职务，公司已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金自2011年4月1日起跟踪的标的指数由原来的中信标普300指数变更为沪深300指数，而基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略等未发生变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	497,080,734.49	66.69%	422,518.85	67.68%	-
长城证券	1	248,273,834.01	33.31%	201,724.39	32.32%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：无

2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	5,576,634.20	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加国都证券为旗下部分基金代销机构的业务公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 1 月 14 日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 1 月 18 日
3	长城基金管理有限公司关于参加深圳农村商业银行定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 1 月 20 日
4	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持亚太股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 1 月 25 日
5	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持哈药股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 2 月 17 日
6	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 2 月 18 日

7	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 2 月 22 日
8	长城久泰基金变更跟踪指数公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 3 月 10 日
9	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持双汇发展股票估值调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 3 月 23 日
10	长城久泰基金变更跟踪指数的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 3 月 31 日
11	关于基金参加“华夏银行-盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 4 月 6 日
12	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持上海汽车、华域汽车股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 4 月 7 日
13	关于天源证券增加为代销机构及开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 4 月 15 日
14	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持安信信托股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 4 月 27 日
15	长城基金关于在中信证券开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 4 月 28 日
16	长城基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 5 月 6 日
17	关于与通联支付合作开通工商银行、光大银行、平安银行借记卡网上交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 5 月 16 日
18	关于东莞农村商业银行增加为代销机构及开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 5 月 17 日
19	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 5 月 26 日
20	关于开通中投证券定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 6 月 9 日
21	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网	中国证券报、证券时报、上海证券报和本	2011 年 6 月 29 日

	银、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人网站	
22	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011 年 6 月 30 日
23	本报告期刊登的其他公告	-	-

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

（一）本基金设立批准的相关文件

（二）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

（三）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》

（四）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会规定的其他文件

11.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

公司网址：http://www.ccfund.com.cn